

# 国寿安保稳健回报混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金的基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 其他指标.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	41
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41

7.12 投资组合报告附注.....	41
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>42</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	42
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>43</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
其他重大事件.....	45
10.8.....	45
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>46</b>
11.1 备查文件目录.....	46
11.2 存放地点.....	46
11.3 查阅方式.....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保稳健回报混合型证券投资基金	
基金简称	国寿安保稳健回报混合	
基金主代码	001846	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 11 月 26 日	
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	180,298,381.94 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	国寿安保稳健回报 A	国寿安保稳健回报 C
下属分级基金的交易代码:	001846	002312
报告期末下属分级基金的份额总额	180,229,205.86 份	69,176.08 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将通过对宏观经济和资本市场的深入分析,采用主动的投资管理策略,把握不同时期各金融市场的收益水平,在约定的投资比例下,配置股票、债券、货币市场工具等各类资产,在有效控制下行风险的前提下,力争为投资人获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的资产配置策略注重将定性资产配置和定量资产配置进行有机的结合,根据经济情景、类别资产收益风险预期等因素,确定不同阶段基金资产中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例,追求绝对收益,回避市场风险。
业绩比较基准	中债综合(全价)指数收益率 X 80%+ 沪深 300 指数收益率 X 20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,股票资产占基金资产的比例为 0%-40%。从预期风险收益方面看,本基金的预期风险收益水平相应会高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中高风险收益的投资品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国寿安保基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张彬
	联系电话	010-50850744
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn
客户服务电话	4009-258-258	95528
传真	010-50850776	021-63602540
注册地址	上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	上海市中山东一路 12 号
办公地址	北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层	上海市中山东一路 12 号
邮政编码	100033	200120

法定代表人	刘慧敏	吉晓辉
-------	-----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国寿安保基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	国寿安保稳健回报 A	国寿安保稳健回报 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,545,680.60	563.76
本期利润	2,668,946.08	1,331.36
加权平均基金份额本期利润	0.0115	0.1050
本期加权平均净值利润率	1.16%	10.41%
本期基金份额净值增长率	1.39%	3.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	1,887,460.62	661.83
期末可供分配基金份额利润	0.0105	0.0096
期末基金资产净值	184,205,169.59	70,636.80
期末基金份额净值	1.022	1.021
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	2.20%	3.03%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国寿安保稳健回报 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.69%	0.10%	0.20%	0.21%	1.49%	-0.11%

过去三个月	2.71%	0.22%	-0.77%	0.21%	3.48%	0.01%
过去六个月	1.39%	0.29%	-3.15%	0.38%	4.54%	-0.09%
自基金合同生效起至今	2.20%	0.27%	-2.28%	0.37%	4.48%	-0.10%

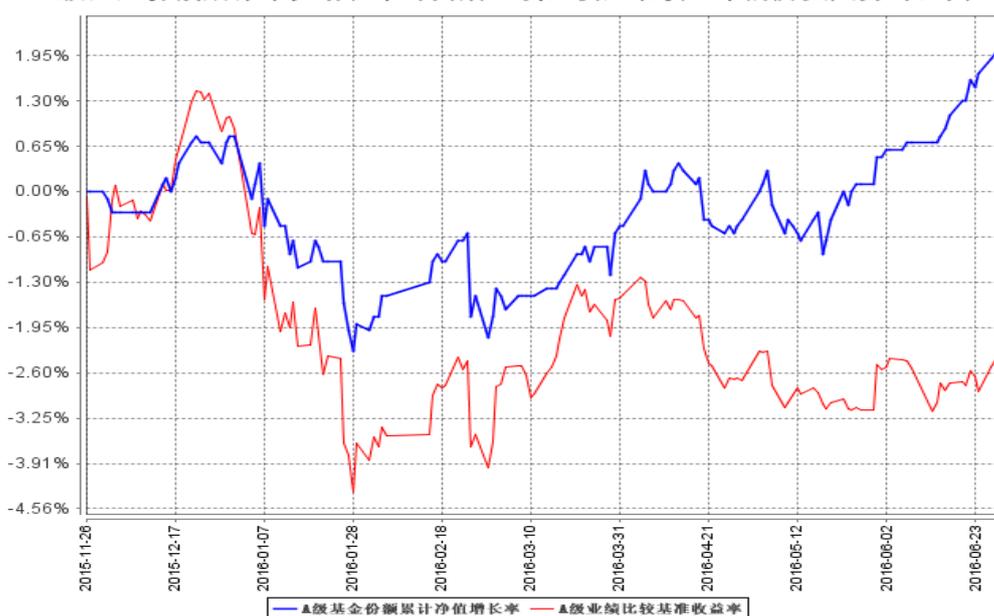
国寿安保稳健回报 C

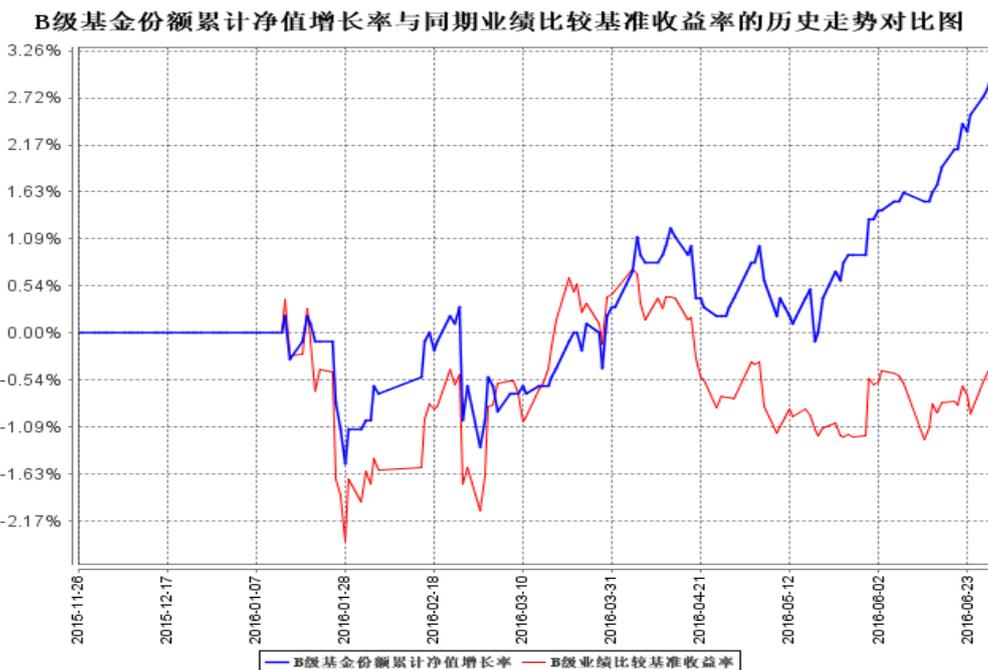
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.69%	0.11%	0.20%	0.21%	1.49%	-0.10%
过去三个月	2.72%	0.21%	-0.77%	0.21%	3.49%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.03%	0.28%	-0.33%	0.32%	3.36%	-0.04%

注：本基金 C 类份额作为新增份额自 2016 年 1 月 4 日起开放申购赎回业务，于 2016 年 1 月 14 日正式发生申购业务，因此相关财务指标自 2016 年 1 月 14 日起计算。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A 级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





注：本基金基金合同生效日为 2015 年 11 月 26 日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为 2015 年 11 月 26 日至 2016 年 6 月 30 日。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2013]1308 号文核准，于 2013 年 10 月 29 日设立，公司注册资本 5.88 亿元人民币，公司股东为中国人寿资产管理有限公司，其持有股份 85.03%，AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED（澳大利亚安保资本投资有限公司），其持有股份 14.97%。

截至 2016 年 6 月 30 日，公司共管理 21 只开放式基金及部分特定资产管理计划，公司管理资产总规模为 788.64 亿元，其中公募基金管理规模为 533.27 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明

		任职日期	离任日期		
董瑞倩	投资管理部总经理、基金经理	2015 年 11 月 26 日	-	19 年	董瑞倩女士，硕士。曾任工银瑞信基金管理有限公司专户投资部基金经理，中银国际证券有限责任公司定息收益部副总经理、执行总经理；现任国寿安保基金管理有限公司投资管理部总经理，国寿安保尊享债券型证券投资基金、国寿安保尊益信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、国寿安保稳定回报混合型证券投资基金、国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金、国寿安保稳健回报混合型证券投资基金、国寿安保保本混合型证券投资基金及国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金基金经理。
吴闻	基金经理	2015 年 11 月 26 日	-	8 年	吴闻先生，硕士。曾任中信证券股份有限公司债务资本市场部高级经理，固定收益部副总裁，2014 年 9 月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理，现任国寿安保稳定回报混合型证券投资基金、国寿安保稳健回报混合型证券投资基金及国寿安保保本混合型证券投资基金基金经理。

注：任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于基金份额持有人为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执

行，严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。本报告期，不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为；且不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年中国经济在一季度逐渐显露短期企稳迹象之后，二季度市场逐步调降经济增长预期，一方面房地产销量增速逐步回落，货币信贷数据的强势也未能延续，通胀预期也有明显减弱；另一方面人民日报权威人士发声消除了经济强刺激的可能性，阐述了中国经济长期进入 L 型增长的原因，而央行的货币政策也维持中性，以稳为主，通过构筑利率走廊稳定资金利率价格，并设立新的汇率中间价机制引导人民币相对于一篮子货币小幅贬值。与此同时，英国脱欧公投获得通过带动了全球避险需求升温，以美国及德国 10 年国债为代表的资产价格全线上涨。

在经过一季度债券收益率的上行之后，二季度国内债券市场利率下降的幅度较大。经济基本面弱化对债市提供支撑，且高息资产逐步到期后，银行理财等机构加大配置力度是推动债券市场上涨的主要力量。权益市场方面，年初受汇率贬值、产业资本减持预期等因素影响，A 股市场快速下跌。随着汇率市场平稳、股票供给预期减弱，市场信心得到修复，3 月份之后 A 股震荡回升，行情主要受风险偏好主导，食品饮料、电子、有色金属、新能源汽车等领域表现活跃。

本基金在报告期内根据经济形势和基金申赎的变化，延续了稳健的投资风格，积极调整信用债的持仓结构，并在有效控制回撤的基础上，灵活调整权益仓位。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.022 元，累计份额净值为 1.022 元，C 类基金份额净值为 1.021 元，累计份额净值为 1.021 元。报告期内 A 类基金份额净值增长率为 1.39%，同期业绩基准涨幅为-3.15%，C 类基金份额净值增长率为 3.03%，同期业绩基准涨幅为-0.33%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年中国经济的主要支撑力来自于政府财政赤字的扩张和居民加杠杆购置房产，全年来看中国经济始终面临企业部门去杠杆和总体私人部门内生增长动力不足的困局。展望下半年，中国经济的最大风险点在于房地产市场成交热度的逐渐消退，考虑到目前地产刺激政策的出台愈发谨慎，进入四季度房地产投资和新开工的下行压力预计会加大，出口和消费预计也难以抵消房地产市场趋冷对经济的拖累，因此后期稳增长需要政府发挥更加积极的作用，预计财政政策将继续加码，货币政策也可能存在放松的可能性。

对于债券市场而言，16 年下半年经济基本面和政策面将继续为债券市场提供支撑，此外机构配置行为和债券供需关系更加值得关注，银行理财，保险等机构仍在加大对债券市场的配置力度，而房地产和基建投资融资渠道的拓宽使得非标等高息金融资产供给仍在萎缩，因此总体来看下半年后期债券市场利率可能仍有进一步下行的空间。

权益市场方面，海外政治周期、美联储加息节奏以及国内经济下行压力增大、金融市场降杠杆将是下半年的风险因素，股市整体估值水平可能趋于下行。不过，在利率降低、金融机构缺乏安全资产的环境下，绩优价值股的投资价值逐渐增强，同时新兴行业具有真实成长性的股票仍将获得估值溢价。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行。本基金管理人设有基金估值委员会，估值委员会负责人由公司领导担任，委员由运营管理部负责人、监察稽核部负责人、研究部负责人组成，估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供在银行间同业市场交易和在交易所市场交易的债券品种

的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对国寿安保稳健回报混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对国寿安保稳健回报混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由国寿安保基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：国寿安保稳健回报混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,081,230.14	33,658,751.01
结算备付金		2,463,807.23	947,619.05
存出保证金		236,455.52	-
交易性金融资产	6.4.7.2	145,412,045.78	97,740,266.79
其中: 股票投资		23,935,954.28	23,095,567.39
基金投资		-	-
债券投资		121,476,091.50	74,644,699.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	34,200,245.00	90,000,575.00
应收证券清算款		4,581,330.36	27,504,718.88
应收利息	6.4.7.5	1,463,415.89	564,075.86
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		189,438,529.92	250,416,006.59
<b>负债和所有者权益</b>			
	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	3,400,000.00
应付证券清算款		4,571,480.32	-
应付赎回款		2,029.83	-
应付管理人报酬		144,648.20	142,279.53
应付托管费		32,545.85	32,012.91
应付销售服务费		19.27	-
应付交易费用	6.4.7.7	332,438.76	18,025.98
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	79,561.30	10,000.00
负债合计		5,162,723.53	3,602,318.42
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	180,298,381.94	244,937,632.53
未分配利润	6.4.7.10	3,977,424.45	1,876,055.64
所有者权益合计		184,275,806.39	246,813,688.17

负债和所有者权益总计		189,438,529.92	250,416,006.59
------------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.022 元，基金份额总额 180,298,381.94 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国寿安保稳健回报混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		5,084,667.22
1.利息收入		3,662,880.85
其中：存款利息收入	6.4.7.11	173,845.52
债券利息收入		3,056,343.19
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		432,692.14
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		260,671.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	962,986.96
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-738,373.70
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	36,057.81
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,124,033.08
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	37,082.22
<b>减：二、费用</b>		2,414,389.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	922,313.11
2. 托管费	6.4.10.2.2	207,520.43
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	19.27
4. 交易费用	6.4.7.19	808,379.32
5. 利息支出		376,874.18
其中：卖出回购金融资产支出		376,874.18
6. 其他费用	6.4.7.20	99,283.47
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,670,277.44
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2,670,277.44



本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类金融工具，债券等固定收益类金融工具（包括国债、中央银行票据、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债、证券公司短期公司债、资产支持证券、可转换债券、可交换债券、债券回购、银行存款等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-40%；本基金持有不低于基金资产净值的 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本基金的报告期间为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）。

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融

资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在

是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括红利再投资、基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.18% 的年费率逐日计提；

(3) C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.30% 的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 本基金每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

#### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### **6.4.6 税项**

#### **6.4.6.1 印花税**

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### **6.4.6.2 营业税、企业所得税**

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税

收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### **6.4.6.3 个人所得税**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### **6.4.7 重要财务报表项目的说明**

#### **6.4.7.1 银行存款**

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	1,081,230.14
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,081,230.14

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	20,969,085.57	23,935,954.28	2,966,868.71
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	92,401,028.80	91,540,091.50
	银行间市场	29,986,000.00	29,936,000.00
	合计	122,387,028.80	121,476,091.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	143,356,114.37	145,412,045.78	2,055,931.41

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	30,000,245.00	-
买入返售证券	4,200,000.00	-
合计	34,200,245.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	18,611.85
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,108.70
应收债券利息	1,437,905.52
应收买入返售证券利息	5,683.42
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	106.40
合计	1,463,415.89

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金于本期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	324,925.51
银行间市场应付交易费用	7,513.25
合计	332,438.76

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
审计费	29,835.26
信息披露费	49,726.04
合计	79,561.30

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

国寿安保稳健回报 A		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	244,937,632.53	244,937,632.53
本期申购	2,244.76	2,244.76
本期赎回(以“-”号填列)	-64,710,671.43	-64,710,671.43
- 基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	180,229,205.86	180,229,205.86

金额单位：人民币元

国寿安保稳健回报 C		
项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	69,578.18	69,578.18
本期赎回(以“-”号填列)	-402.10	-402.10
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	69,176.08	69,176.08

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

国寿安保稳健回报 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	738,478.21	1,137,577.43	1,876,055.64
本期利润	1,545,680.60	1,123,265.48	2,668,946.08
本期基金份额交易产生的变动数	-396,698.19	-172,339.80	-569,037.99
其中：基金申购款	-3.33	-10.71	-14.04
基金赎回款	-396,694.86	-172,329.09	-569,023.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,887,460.62	2,088,503.11	3,975,963.73

单位：人民币元

国寿安保稳健回报 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	563.76	767.60	1,331.36
本期基金份额交易产生的变动数	98.07	31.29	129.36
其中：基金申购款	98.60	31.06	129.66
基金赎回款	-0.53	0.23	-0.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	661.83	798.89	1,460.72

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	145,651.33
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	27,308.30
其他	885.89
合计	173,845.52

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	306,169,382.41
减：卖出股票成本总额	305,206,395.45
买卖股票差价收入	962,986.96

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-738,373.70
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-738,373.70

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	211,327,529.57
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	209,027,502.21
减：应收利息总额	3,038,401.06
买卖债券差价收入	-738,373.70

**6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金于本报告期无衍生工具产生的收益/损失。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	36,057.81
基金投资产生的股利收益	-
合计	36,057.81

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	1,124,033.08
——股票投资	2,132,358.30
——债券投资	-1,008,325.22
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	1,124,033.08

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	37,066.76
转换费收入 001846	15.46
合计	37,082.22

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	805,629.32
银行间市场交易费用	2,750.00
合计	808,379.32

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	49,726.04
中债登账户维护费	4,500.00
银行费用	10,422.17
上清所账户维护费	4,500.00
其他	300.00
合计	99,283.47

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）	基金管理人、注册登记机构、直销机构
上海浦东发展银行股份有限公司（简称“浦发银行”）	基金托管人、销售机构
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	基金管理人的最终控制人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的交易。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	922,313.11	-
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	-

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	207,520.43	-

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.18% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.18\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国寿安保稳健回报 A	国寿安保稳健回报 C	合计
国寿安保	-	19.27	19.27
合计	-	19.27	19.27

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。销售服务费每日计提，按月支付。销售服务费按前一日的基金资产净值的 0.30% 的年费率计提，

计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本报告期内未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

国寿安保稳健回报 A				
关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
集团公司	179,999,000.00	99.87%	179,999,000.00	73.49%

##### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	1,081,230.14	145,651.33	-	-

##### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

##### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金于本报告期末进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300508	维宏股份	2016 年 4 月 12 日	2017 年 4 月 19 日	新股锁定	20.08	254.50	10,383	208,490.64	2,642,473.50	-
601966	玲珑轮胎	2016 年 6 月 24 日	2016 年 7 月 6 日	新股流通受限	12.98	12.98	1,928	25,025.44	25,025.44	-
603016	新宏泰	2016 年 6 月 23 日	2016 年 7 月 1 日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127003	海印转债	2016 年 6 月 15 日	2016 年 7 月 1 日	新债未上市	100.00	100.00	1,200	120,000.00	120,000.00	-

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601611	中国核建	2016 年 6 月 30 日	临时停牌	20.92	2016 年 7 月 1 日	23.01	7,361	25,542.67	153,992.12	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人根据现代企业法人治理结构和内部控制的要求，建立在董事会领导

下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。风险控制的体系由公司董事会、风险管理委员会、经理层、督察长、监察稽核部和各业务部门业务人员岗位自控构成。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本

基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及结算保证金等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,081,230.14	-	-	-	1,081,230.14
结算备付金	2,463,807.23	-	-	-	2,463,807.23
存出保证金	236,455.52	-	-	-	236,455.52
交易性金融资产	42,317,662.50	29,953,000.00	49,205,429.00	23,935,954.28	145,412,045.78
买入返售金融资产	34,200,245.00	-	-	-	34,200,245.00
应收证券清算款	-	-	-	4,581,330.36	4,581,330.36
应收利息	-	-	-	1,463,415.89	1,463,415.89
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	80,299,400.39	29,953,000.00	49,205,429.00	29,980,700.53	189,438,529.92
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,571,480.32	4,571,480.32
应付赎回款	-	-	-	2,029.83	2,029.83
应付管理人报酬	-	-	-	144,648.20	144,648.20
应付托管费	-	-	-	32,545.85	32,545.85
应付销售服务费	-	-	-	19.27	19.27
应付交易费用	-	-	-	332,438.76	332,438.76
其他负债	-	-	-	79,561.30	79,561.30
负债总计	-	-	-	5,162,723.53	5,162,723.53
利率敏感度缺口	80,299,400.39	29,953,000.00	49,205,429.00	24,817,977.00	184,275,806.39
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	33,658,751.01	-	-	-	33,658,751.01
结算备付金	947,619.05	-	-	-	947,619.05
交易性金融资产	38,370,809.20	20,102,640.00	16,171,250.20	23,095,567.39	97,740,266.79
买入返售金融资产	90,000,575.00	-	-	-	90,000,575.00
应收证券清算款	-	-	-	27,504,718.88	27,504,718.88
应收利息	-	-	-	564,075.86	564,075.86
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	162,977,754.26	20,102,640.00	16,171,250.20	51,164,362.13	250,416,006.59
负债					
卖出回购金融资产款	3,400,000.00	-	-	-	3,400,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	142,279.53	142,279.53
应付托管费	-	-	-	32,012.91	32,012.91

应付交易费用	-	-	-	18,025.98	18,025.98
其他负债	-	-	-	10,000.00	10,000.00
负债总计	3,400,000.00	-	-	202,318.42	3,602,318.42
利率敏感度缺口	159,577,754.26	20,102,640.00	16,171,250.20	50,962,043.71	246,813,688.17

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	+25 个基点	-901,080.01	-445,038.77
	-25 个基点	901,080.01	445,038.77

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券或银行间同业市场交易的债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-40%；本基金持有不低于基金资产净值的 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。于 2016 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

交易性金融资产-股票投资	23,935,954.28	12.99	23,095,567.39	9.36
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	121,476,091.50	65.92	74,644,699.40	30.24
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	145,412,045.78	78.91	97,740,266.79	39.60

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金主要投资于固定收益品种，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、存出保证金等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 21,100,862.24 元，属于第二层次的余额为人民币 124,311,183.50 元，无属于第三层次的余额。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转移。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

##### 6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 8 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	23,935,954.28	12.64
	其中：股票	23,935,954.28	12.64
2	固定收益投资	121,476,091.50	64.12
	其中：债券	121,476,091.50	64.12
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	34,200,245.00	18.05
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,545,037.37	1.87
7	其他各项资产	6,281,201.77	3.32
8	合计	189,438,529.92	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,121,534.28	1.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,727,591.18	1.48
E	建筑业	153,992.12	0.08
F	批发和零售业	2,615,445.00	1.42
G	交通运输、仓储和邮政业	2,144,122.00	1.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,685,856.60	1.46
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,355,907.00	1.28
L	租赁和商务服务业	1,839,264.00	1.00
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	6,272,116.00	3.40

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	23,935,954.28	12.99

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002701	奥瑞金	312,300	2,757,609.00	1.50
2	000069	华侨城 A	430,400	2,754,560.00	1.49
3	600900	长江电力	218,382	2,727,591.18	1.48
4	300508	维宏股份	10,383	2,642,473.50	1.43
5	601607	上海医药	144,900	2,615,445.00	1.42
6	000888	峨眉山 A	189,500	2,281,580.00	1.24
7	600029	南方航空	303,700	2,144,122.00	1.16
8	600138	中青旅	95,200	1,839,264.00	1.00
9	002285	世联行	169,700	1,321,963.00	0.72
10	000978	桂林旅游	117,600	1,235,976.00	0.67
11	000886	海南高速	160,800	1,033,944.00	0.56
12	601611	中国核建	7,361	153,992.12	0.08
13	601127	小康股份	3,647	87,053.89	0.05
14	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.04
15	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.03
16	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.03
17	300518	盛讯达	926	43,383.10	0.02
18	603958	哈森股份	1,819	26,375.50	0.01
19	601966	玲珑轮胎	1,928	25,025.44	0.01
20	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
21	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
22	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.01

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600499	科达洁能	24,890,604.98	10.08
2	000592	平潭发展	21,403,270.84	8.67
3	002467	二六三	17,260,191.54	6.99
4	600900	长江电力	15,369,130.70	6.23
5	000978	桂林旅游	14,000,365.63	5.67
6	600138	XD 中青旅	13,058,377.00	5.29
7	002104	恒宝股份	10,451,283.37	4.23
8	600410	华胜天成	9,384,184.00	3.80
9	000786	北新建材	8,598,705.00	3.48
10	600563	法拉电子	7,206,597.35	2.92
11	600418	江淮汽车	6,889,409.00	2.79
12	600029	南方航空	6,779,810.00	2.75
13	000001	平安银行	6,764,760.00	2.74
14	600376	首开股份	6,690,283.54	2.71
15	600115	东方航空	6,034,467.00	2.44
16	000860	顺鑫农业	5,997,638.00	2.43
17	600486	扬农化工	5,966,126.00	2.42
18	600057	象屿股份	5,787,454.00	2.34
19	000513	丽珠集团	5,655,944.00	2.29
20	600382	广东明珠	5,648,647.00	2.29
21	002510	天汽模	4,998,264.00	2.03

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600499	科达洁能	25,578,819.91	10.36
2	000592	平潭发展	21,495,316.12	8.71
3	002467	二六三	18,080,871.31	7.33
4	000978	桂林旅游	16,571,932.89	6.71
5	600138	XD 中青旅	14,263,445.00	5.78
6	600900	长江电力	12,957,239.43	5.25
7	002104	恒宝股份	10,737,562.98	4.35
8	600410	华胜天成	9,077,134.04	3.68

9	000786	北新建材	8,738,906.00	3.54
10	603899	晨光文具	7,736,386.64	3.13
11	000001	平安银行	7,575,141.67	3.07
12	600563	法拉电子	7,399,432.35	3.00
13	600376	首开股份	7,220,886.12	2.93
14	600418	江淮汽车	6,748,266.00	2.73
15	000860	顺鑫农业	6,709,329.00	2.72
16	600486	扬农化工	6,195,337.00	2.51
17	000513	丽珠集团	5,982,835.73	2.42
18	600382	广东明珠	5,800,992.19	2.35
19	600115	东方航空	5,727,830.09	2.32
20	600057	象屿股份	5,557,676.23	2.25
21	002510	天汽模	5,369,471.00	2.18

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	303,914,424.04
卖出股票收入（成交）总额	306,169,382.41

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	11,992,800.00	6.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	89,466,291.50	48.55
5	企业短期融资券	9,876,000.00	5.36
6	中期票据	10,021,000.00	5.44
7	可转债（可交换债）	120,000.00	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	121,476,091.50	65.92

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019533	16 国债 05	120,000	11,992,800.00	6.51
2	1680018	16 四会国资债	100,000	10,039,000.00	5.45
3	101660010	16 冀旅投 MTN001	100,000	10,021,000.00	5.44
4	136311	16 中化 01	100,000	9,996,000.00	5.42
5	127357	16 永经投	100,000	9,946,000.00	5.40

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	236,455.52
2	应收证券清算款	4,581,330.36
3	应收股利	-
4	应收利息	1,463,415.89
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	6,281,201.77

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300508	维宏股份	2,642,473.50	1.43	新股锁定

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国寿安保稳健回报 A	184	979,506.55	179,999,000.00	99.87%	230,205.86	0.13%
国寿安保稳健回报 C	17	4,069.18	0.00	0.00%	69,176.08	100.00%
合计	201	897,006.88	179,999,000.00	99.83%	299,381.94	0.17%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国寿安保稳健回报 A	94,535.50	0.05%
	国寿安保稳健回报 C	704.85	1.02%
	合计	95,240.35	0.05%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持	国寿安保稳健回报 A	0~10
	国寿安保稳健回报 C	0

有本开放式基金	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国寿安保稳健回报 A	0~10
	国寿安保稳健回报 C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国寿安保稳健回报 A	国寿安保稳健回报 C
基金合同生效日（2015 年 11 月 26 日） 基金份额总额	200,403,550.87	-
本报告期期初基金份额总额	244,937,632.53	-
本报告期基金总申购份额	2,244.76	69,578.18
减：本报告期基金总赎回份额	64,710,671.43	402.10
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	180,229,205.86	69,176.08

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

(2) 自 2016 年 1 月起，上海浦东发展银行进行组织架构优化调整并变更部门名称，聘任刘长江同志为资产托管部总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	2	608,772,836.94	100.00%	445,195.99	100.00%	-

注：根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，我在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 综合实力较强、市场信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营状况稳健；
- (3) 经营行为规范，具备健全的内部控制制度；
- (4) 研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；
- (5) 具有丰富的投行资源和大宗交易信息，愿意积极为我公司提供相关投资机会，能够对公司业务发展形成支持；
- (6) 具有费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供全面的交易信息服务；
- (7) 从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1) 公司根据上述标准确定选用交易单元的证券经营机构；
- (2) 公司和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

银河证券	91,417,226.86	100.00%	2,961,500,000.00	100.00%	-	-
------	---------------	---------	------------------	---------	---	---

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务的公告	《上海证券报》及公司网站	2016年6月30日
2	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金参加好买基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》及公司网站	2016年5月10日
3	国寿安保稳健回报混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	《上海证券报》及公司网站	2016年4月22日
4	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金参加同花顺、新兰德费率优惠活动公告	《上海证券报》及公司网站	2016年4月7日
5	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金新增中信期货有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》及公司网站	2016年3月25日
6	国寿安保基金管理有限公司新增珠海盈米财富管理有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》及公司网站	2016年3月22日
7	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	《上海证券报》及公司网站	2016年3月22日
8	国寿安保基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告	《上海证券报》及公司网站	2016年3月12日
9	国寿安保基金管理有限公司新增北京懒猫金融信息服务有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》及公司网站	2016年3月4日
10	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金新增华西证券股份有限公司、恒天明泽基金销售有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》及公司网站	2016年3月1日
11	国寿安保基金管理有限公司关于调整旗下基金最低申购金额的公告	《上海证券报》及公司网站	2016年2月27日
12	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金开通网上直销业务的公告	《上海证券报》及公司网站	2016年1月13日
13	国寿安保基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《上海证券报》及公司网站	2016年1月6日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 11.1.1 中国证监会批准国寿安保稳健回报混合型证券投资基金募集的文件
- 11.1.2 《国寿安保稳健回报混合型证券投资基金基金合同》
- 11.1.3 《国寿安保稳健回报混合型证券投资基金托管协议》
- 11.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 11.1.5 报告期内国寿安保稳健回报混合型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告
- 11.1.6 中国证监会要求的其他文件

### 11.2 存放地点

国寿安保基金管理有限公司, 地址:北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

### 11.3 查阅方式

- 11.3.1 营业时间内到本公司免费查阅
- 11.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息: [www.gsfunds.com.cn](http://www.gsfunds.com.cn)
- 11.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询: 4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司  
2016 年 8 月 26 日